

# 大成现金增利货币市场基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 债券回购融资情况.....	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	43
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	45

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	45
7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	52
10.9 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成现金增利货币市场基金	
基金简称	大成现金增利货币	
基金主代码	090022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 11 月 20 日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	30,791,679,480.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B
下属分级基金的交 易代码	090022	091022
报告期末下属分级 基金的份额总额	30,791,484,877.80 份	194,602.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产的低风险和高流动性的前提下，争取获得超过基金业绩比较基准的收益率。
投资策略	本基金投资管理将充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略首先审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静
	联系电话	0755-83183388
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn
客户服务电话	4008885558	95599
传真	0755-83199588	010-68121816
注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道	北京市西城区复兴门内大街 28

	1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	吴庆斌	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B
本期已实现收益	287,767,167.73	2,670.20
本期利润	287,767,167.73	2,670.20
本期净值收益率	0.9191%	1.0391%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	30,791,484,877.80	194,602.57
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	33.9533%	37.0742%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成现金增利货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1288%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.1000%	0.0002%
过去三个月	0.4279%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.3406%	0.0004%
过去六个月	0.9191%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.7455%	0.0005%
过去一年	1.9272%	0.0005%	0.3500%	0.0000%	1.5772%	0.0005%
过去三年	6.0752%	0.0008%	1.0500%	0.0000%	5.0252%	0.0008%
自基金合同生效起至今	33.9533%	0.0053%	3.3638%	0.0000%	30.5895%	0.0053%

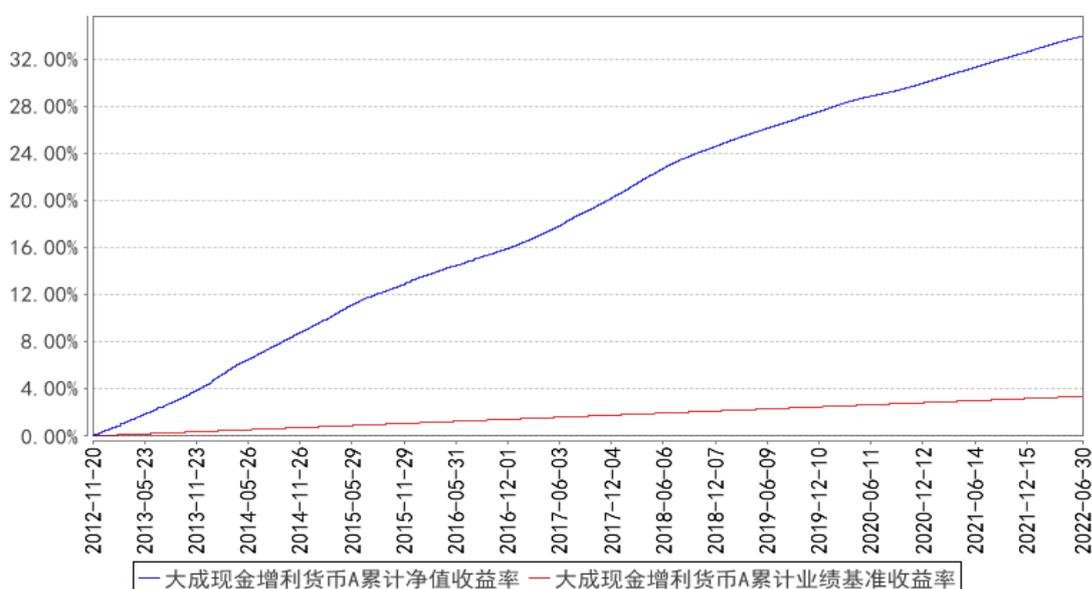
大成现金增利货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1485%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.1197%	0.0002%
过去三个月	0.4879%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.4006%	0.0004%
过去六个月	1.0391%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.8655%	0.0005%

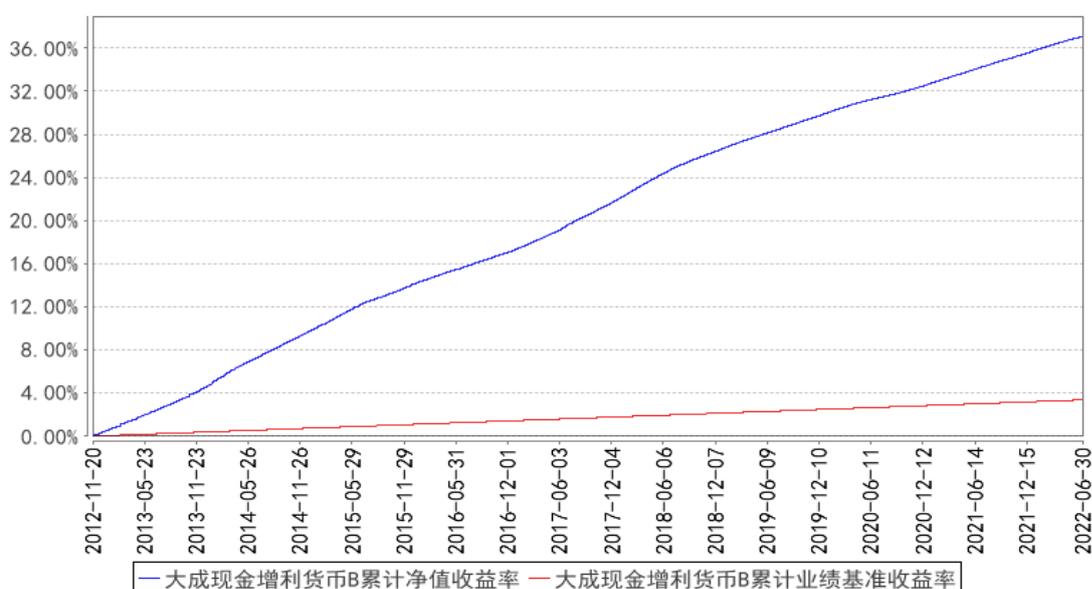
过去一年	2.1720%	0.0005%	0.3500%	0.0000%	1.8220%	0.0005%
过去三年	6.8414%	0.0008%	1.0500%	0.0000%	5.7914%	0.0008%
自基金合同生效起 至今	37.0742%	0.0053%	3.3638%	0.0000%	33.7104%	0.0053%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成现金增利货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



大成现金增利货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准，于1999年4月12日正式成立，是中国证监会批准成立的首批十家基金管理公司之一，注册资本为2亿元人民币，注册地为深圳。目前公司由三家股东组成，分别为中泰信托有限责任公司(50%)、光大证券股份有限公司(25%)、中国银河投资管理有限公司(25%)。公司业务资质齐全，是全国同时具有境内、境外社保基金管理人资格和基本养老保险基金管理人资格的四家基金公司之一，全面涵盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理、私募股权投资等业务，旗下大成国际资产管理公司具备QFII、RQFII等资格。

历经23年的发展，大成基金形成了以长期投资能力为核心竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。目前已形成权益、固定收益、量化投资、商品期货、境外投资、大类资产配置等六大投资团队，全面覆盖各类投资领域。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈会荣	本基金基金经理，固定收益总部副总监	2018年8月17日	-	15年	中央财经大学经济学学士。2004年7月至2007年10月就职于招商银行总行，任资产托管部年金小组组长。2007年10月加入大成基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金助理会计师、基金运营部登记清算主管、固定收益总部助理研究员、固定收益总部基金经理助理、固定收益总部总监助理，现任固定收益总部副总监。2016年8月6日至2018年10月20日任大成景穗灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月6日起任大成丰财宝货币市场基金基金经理。2016年9月6日至2019年9月29日任大成恒丰宝货币市场基金基金经理。2016年11月2日至2019年9月29日任大成惠利纯债债券型证券投资基金、大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月1日至2019年9月29日任大成惠祥纯债债券型证券投资

					基金（原大成惠祥定期开放纯债债券型证券投资基金转型）基金经理。2017年3月22日至2022年8月9日任大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金（原大成月添利理财债券型证券投资基金）基金经理。2017年3月22日至2019年9月29日任大成慧成货币市场基金基金经理。2017年3月22日至2020年3月11日任大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年3月14日起任大成添利宝货币市场基金基金经理。2018年3月14日至2020年6月29日任大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2018年8月17日起任大成现金增利货币市场基金基金经理。2019年9月20日起任大成货币市场证券投资基金基金经理。2020年7月1日起任大成惠祥纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年7月1日至2021年11月12日任大成惠益纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年8月17日至2022年3月4日任大成惠享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
--	--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、曾婷婷女士自2022年7月1日起增聘为本基金基金经理。上述事项已按法规要求及公司相关制度办理，变更流程合法合规。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。基金管理人运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内及5日内股票及债券交易同向交易价

差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。主动投资组合间股票交易存在 1 笔同日反向交易，原因为投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易，但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的情形；主动投资组合间债券交易存在 2 笔同日反向交易，原因为流动性需要或合规比例调整。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，债券收益率经历了窄幅震荡行情。年初降息，央行下调 OMO 和 MLF、LPR 利率，资金面较为宽松，债券收益率经历一波小幅下行。后社融信贷数据超预期，以及市场对宽信用的担忧，美联储加息预期等，债券收益率上行。2-3 月开始，地缘政治冲突叠加多地疫情相继冲击，资金面充裕，资金利率明显下行，债券收益率也随之下行。资金利率维持低位，短端资产的确定性更强，收益率下行幅度较大，shibor3m 直接下行至 2%，1 年国股存单最低到 2.27% 左右的位置。存单和利率债在资金中枢没有明显抬升的情况下窄幅震荡。

本基金以流动性为第一前提，根据组合特点在合理期限范围内配置组合资产，努力提高组合静态收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期大成现金增利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9191%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%，本报告期大成现金增利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0391%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情有所缓解，以及稳增长政策的逐步落地，市场预计经济将进入弱复苏阶段。汽车等消费改善较为明显，带动社零一定程度回升。基建和制造业拉动投资，房地产销售改善方向确定

但幅度较为有限，销售向投资传导需要更长的时间，并且效果有待观察。随着外需回落，出口将边际走弱。疫情并没有完全消除，依然会对经济产生扰动，经济基本面呈现弱复苏态势。预计下半年货币政策依然偏宽松，但目前资金利率水平较低，债市的绝对收益水平偏低，空间较为有限，需要提防超预期事件导致债券市场的回调压力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括七名投资组合经理。

股票投资部、固定收益总部、研究部、指数与期货投资部、大类资产配置部、权益专户投资部、国际业务部、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配

有关原则的规定：本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资人每日计算收益并分配，按日结转份额，每月集中支付收益。本报告期内本基金应分配利润 287,769,837.93 元，报告期内已分配利润 287,769,837.93 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——大成基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，大成基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，大成基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,590,638,127.84	15,001,167,684.59
结算备付金		7,898,289.44	-
存出保证金		30,540.32	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,893,112,073.67	8,895,334,285.41
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,893,112,073.67	8,895,334,285.41
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,267,549,443.87	7,418,830,893.19
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		50,203,004.59	300,557.32
应收股利		-	-
应收申购款		1,482,381.23	2,860,447.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	170,165,294.67
资产总计		30,810,913,860.96	31,488,659,163.05
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	500,082,729.88
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,445,559.80	8,647,501.06
应付托管费		2,559,260.59	2,620,454.87
应付销售服务费		6,398,109.33	6,541,237.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	98,889.88
应付利润		1,368,117.06	1,922,841.53
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	463,333.81	560,131.22
负债合计		19,234,380.59	520,473,785.96

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	30,791,679,480.37	30,968,185,377.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		30,791,679,480.37	30,968,185,377.09
负债和净资产总计		30,810,913,860.96	31,488,659,163.05

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 30,791,679,480.37 份，其中大成现金增利货币 A 基金份额总额为 30,791,484,877.80 份，基金份额净值 1.0000 元。大成现金增利货币 B 基金份额总额为 194,602.57 份，基金份额净值 1.0000 元。

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		411,084,538.96	463,653,587.79
1. 利息收入		314,771,395.25	459,545,915.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	253,652,529.39	283,462,141.87
债券利息收入		-	100,098,542.75
资产支持证券利息收入		-	1,587,013.86
买入返售金融资产收入		61,118,865.86	74,398,217.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		96,313,143.71	4,107,671.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	96,313,143.71	4,107,671.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		123,314,701.03	131,617,917.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	51,457,114.49	53,515,229.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,593,064.96	16,216,736.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	38,982,352.95	40,086,356.29
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		17,062,093.28	21,556,557.36
其中：卖出回购金融资产支出		17,062,093.28	21,556,557.36
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,155.68	23,959.61
8. 其他费用	6.4.7.23	217,919.67	219,078.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		287,769,837.93	332,035,670.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		287,769,837.93	332,035,670.39
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		287,769,837.93	332,035,670.39

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示；上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：大成现金增利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期	30,968,185,377.09	-	-	30,968,185,377.09

期末净资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	30,968,185,377.09	-	-	30,968,185,377.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-176,505,896.72	-	-	-176,505,896.72
(一)、综合收益总额	-	-	287,769,837.93	287,769,837.93
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-176,505,896.72	-	-	-176,505,896.72
其中:1.基金申购款	184,984,073,402.92	-	-	184,984,073,402.92
2.基金赎回款	-185,160,579,299.64	-	-	-185,160,579,299.64
(三)、本期向基金份额持有人分配	-	-	-287,769,837.93	-287,769,837.93

利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	30,791,679,480.37	-	-	30,791,679,480.37
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	30,351,394,001.95	-	-	30,351,394,001.95
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	30,351,394,001.95	-	-	30,351,394,001.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,629,205,849.94	-	-	1,629,205,849.94
(一)、综合收益总额	-	-	332,035,670.39	332,035,670.39
(二)、	1,629,205,849.94	-	-	1,629,205,849.94

本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	300,316,124,612.97	-	-	300,316,124,612.97
2. 基金赎回款	-298,686,918,763.03	-	-	-298,686,918,763.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-332,035,670.39	-332,035,670.39
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	31,980,599,851.89	-	-	31,980,599,851.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谭晓冈

基金管理人负责人

范瑛

主管会计工作负责人

孙蕊

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

大成现金增利货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1306 文《关于核准大成现金增利货币市场基金募集的批复》核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成现金增利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,864,903,329.03 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2012)验字第 60469430\_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《大成现金增利货币市场基金基金合同》于 2012 年 11 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,866,253,649.51 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,350,320.48 份基金份额。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)。

本基金分设两级基金份额:A 级基金份额和 B 级基金份额。两级基金份额针对不同级别的基金份额持有人,分设不同的基金代码,收取不同销售服务费并单独公布基金日收益和基金 7 日年化收益率。投资者可自行选择认/申购的基金份额等级,不同基金份额登记之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行

存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的,在不改变基金投资目标、投资策略,不改变基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场工具的投资,不需召开持有人大会。具体比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。

本基金的业绩比较基准为银行活期存款利率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证

券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 1、金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

##### （2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产,本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

### 3、收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的投资收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账。

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提。

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

#### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

在首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节表：

	账面价值
<b>银行存款</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	15,001,167,684.59
重分类：转入自应收利息	128,042,684.68
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	15,129,210,369.27
<b>结算备付金</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	-
重分类：转入自应收利息	-
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	-
<b>存出保证金</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	-
重分类：转入自应收利息	-
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	-
<b>交易性金融资产</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	8,895,334,285.41
重分类：转入自应收利息	33,953,195.07
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	8,929,287,480.48
<b>买入返售金融资产</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	7,418,830,893.19
重分类：转入自应收利息	8,169,414.92
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	7,427,000,308.11
<b>应收利息</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	170,165,294.67
重分类：转出至银行存款	-128,042,684.68
重分类：转出至结算备付金	-
重分类：转出至存出保证金	-
重分类：转出至交易性金融资产	-33,953,195.07
重分类：转出至买入返售金融资产	-8,169,414.92
重分类：转出至应收申购款	-
重分类：转出至其他资产	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	不适用
<b>应收申购款</b>	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	2,860,447.87
重分类：转入自应收利息	-
重新计量：预期信用损失准备	-

2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	2,860,447.87
其他资产	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	-
重分类：转入自应收利息	-
重新计量：预期信用损失准备	-
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	-
卖出回购金融资产款	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	500,082,729.88
重分类：转入自应付利息	31,703.24
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	500,114,433.12
应付利息	
2021年12月31日，按原金融工具准则列示的余额	31,703.24
重分类：转出至卖出回购金融资产款	-31,703.24
2022年1月1日，按新金融工具准则列示的余额	不适用

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 1、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1

日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 2、个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税；

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,027,864,044.56
等于：本金	1,027,639,149.09
加：应计利息	224,895.47
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	16,562,774,083.28
等于：本金	16,450,000,000.00
加：应计利息	112,774,083.28

减：坏账准备	-
合计	17,590,638,127.84

注：(1) 定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

(2) 其他存款为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年6月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	60,547,061.64	60,566,498.63	19,436.99	0.0001
	银行间市场	5,832,565,012.03	5,837,086,457.00	4,521,444.97	0.0147
	合计	5,893,112,073.67	5,897,652,955.63	4,540,881.96	0.0147
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,893,112,073.67	5,897,652,955.63	4,540,881.96	0.0147

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,476,684,780.21	-
银行间市场	5,790,864,663.66	-
合计	7,267,549,443.87	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	202,502.08
其中：交易所市场	-
银行间市场	202,502.08
应付利息	-
预提费用	258,231.73
其他	2,600.00
合计	463,333.81

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大成现金增利货币 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,967,988,187.88	30,967,988,187.88
本期申购	184,983,239,865.01	184,983,239,865.01
本期赎回（以“-”号填列）	-185,159,743,175.09	-185,159,743,175.09
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	30,791,484,877.80	30,791,484,877.80

##### 大成现金增利货币 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,189.21	197,189.21
本期申购	833,537.91	833,537.91
本期赎回（以“-”号填列）	-836,124.55	-836,124.55
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	194,602.57	194,602.57

注：申购含红利再投份额(如有)、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 大成现金增利货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	287,767,167.73	-	287,767,167.73
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-287,767,167.73	-	-287,767,167.73
本期末	-	-	-

## 大成现金增利货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	2,670.20	-	2,670.20
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,670.20	-	-2,670.20
本期末	-	-	-

注：本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，即按份额面值 1.00 元转为基金份额。

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,100,009.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	218,189,863.80
结算备付金利息收入	362,598.56
其他	57.04
合计	253,652,529.39

注：其他存款利息收入为根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款产生的利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	94,095,698.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,217,444.76
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	96,313,143.71

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,519,058,370.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,438,869,768.78
减：应计利息总额	77,971,156.60
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,217,444.76

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

**6.4.7.19 股利收益**

无。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.21 其他收入**

无。

**6.4.7.22 信用减值损失**

无。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	69,424.36
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	70,387.94
账户维护费	18,600.00
合计	217,919.67

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
光大证券	601,041,875.00	100.00	-	-

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
光大证券	73,385,672,000.00	100.00	23,925,000,000.00	100.00

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	51,457,114.49	53,515,229.61
其中：支付销售机构的客户维护费	25,512,778.75	26,169,017.96

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,593,064.96	16,216,736.27

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按基金财产净值的 0.10% 费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B	合计
大成基金	314,700.38	5.11	314,705.49
光大证券	227.38	-	227.38
中国农业银行	21,409.90	1.86	21,411.76
合计	336,337.66	6.97	336,344.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B	合计
大成基金	403,947.48	18,972.07	422,919.55
光大证券	227.20	-	227.20
中国农业银行	25,291.25	2.05	25,293.30
合计	429,465.93	18,974.12	448,440.05

注：基金销售服务费每日计算，按月支付。本基金 A 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金

资产净值的 0.25% 的年费率计提；B 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的该类基金份额的基金资产净值

R 为该类基金份额的销售服务年费率

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	15,710,064,000.00	826,537.72
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	1,100,004,000.00	102,766.08

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,027,864,044.56	35,100,009.99	1,567,916.85	40,841,564.45

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

大成现金增利货币 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
288,321,888.58	-	-554,720.85	287,767,167.73	-
大成现金增利货币 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
2,673.82	-	-3.62	2,670.20	-

## 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

## 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控（合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会）、专业监控（监察稽核部、风险管理部）、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和协议存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用评级在 AA+级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	121,448,428.78	-
A-1 以下	-	-
未评级	729,796,465.70	1,614,445,695.46
合计	851,244,894.48	1,614,445,695.46

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,402,879,696.82	6,280,612,008.77
合计	4,402,879,696.82	6,280,612,008.77

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	638,987,482.37	1,000,276,581.18
合计	638,987,482.37	1,000,276,581.18

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的

价格变现。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非正常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 10%，本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 30%，且本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例、投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期皆符合有关法规的要求。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券买卖、债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	15,978,485,906.47	1,612,152,221.37	-	-	17,590,638,127.84
结算备付金	7,898,289.44	-	-	-	7,898,289.44
存出保证金	30,540.32	-	-	-	30,540.32
交易性金融资产	5,163,526,344.45	729,585,729.22	-	-	5,893,112,073.67
买入返售金融资产	7,267,549,443.87	-	-	-	7,267,549,443.87
应收申购款	-	-	-	1,482,381.23	1,482,381.23
应收清算款	-	-	-	50,203,004.59	50,203,004.59
资产总计	28,417,490,524.55	2,341,737,950.59	-	51,685,385.82	30,810,913,860.96
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	8,445,559.80	8,445,559.80
应付托管费	-	-	-	2,559,260.59	2,559,260.59
应付销售服务费	-	-	-	6,398,109.33	6,398,109.33
应付利润	-	-	-	1,368,117.06	1,368,117.06
其他负债	-	-	-	463,333.81	463,333.81
负债总计	-	-	-	19,234,380.59	19,234,380.59
利率敏感度缺口	28,417,490,524.55	2,341,737,950.59	-	32,451,005.23	30,791,679,480.37
<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>6 个月以内</b>	<b>6 个月-1 年</b>	<b>1-5 年</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	12,551,167,684.59	2,450,000,000.00	-	-	15,001,167,684.59
交易性金融资产	7,716,011,411.82	1,179,322,873.59	-	-	8,895,334,285.41
买入返售金融资产	7,418,830,893.19	-	-	-	7,418,830,893.19
应收申购款	-	-	-	2,860,447.87	2,860,447.87
应收证券清算款	-	-	-	300,557.32	300,557.32
其他资产	-	-	-	170,165,294.67	170,165,294.67
资产总计	27,686,009,989.59	3,629,322,873.59	-	173,326,299.86	31,488,659,163.05

	.60	59			
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,647,501.06	8,647,501.06
应付托管费	-	-	-	2,620,454.87	2,620,454.87
卖出回购金融资产款	500,082,729.88	-	-	-	500,082,729.88
应付销售服务费	-	-	-	6,541,237.52	6,541,237.52
应付利润	-	-	-	1,922,841.53	1,922,841.53
应交税费	-	-	-	98,889.88	98,889.88
其他负债	-	-	-	560,131.22	560,131.22
负债总计	500,082,729.88	-	-	20,391,056.08	520,473,785.96
利率敏感度缺口	27,185,927,259.72	3,629,322,873.59	-	-152,935,243.78	30,968,185,377.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	利率上升 25 个基点	-3,465,328.90	-6,953,027.25
	利率下降 25 个基点	3,472,461.81	6,968,563.52

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	5,893,112,073.67	8,895,334,285.41
第三层次	-	-
合计	5,893,112,073.67	8,895,334,285.41

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,893,112,073.67	19.13
	其中：债券	5,893,112,073.67	19.13
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	7,267,549,443.87	23.59
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	17,598,536,417.28	57.12
4	其他各项资产	51,715,926.14	0.17
5	合计	30,810,913,860.96	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.00	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值 的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

无。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

注：截至报告期末，本基金因规模变动导致组合平均剩余期限被动超过 90 天。

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	33.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	25.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.58	-

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	190,179,060.66	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,178,604,887.41	3.83
	其中：政策性金融债	1,178,604,887.41	3.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	121,448,428.78	0.39
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,402,879,696.82	14.30
8	其他	-	-
9	合计	5,893,112,073.67	19.14
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	按实际利率计算的账面价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112298211	22 宁波银行 CD109	5,000,000	499,254,841.76	1.62
2	112298602	22 深圳农商银行 CD033	5,000,000	498,877,563.44	1.62
3	112280914	22 厦门银行 CD082	4,000,000	396,206,167.24	1.29
4	210407	21 农发 07	3,800,000	387,247,286.54	1.26
5	200312	20 进出 12	3,000,000	308,307,685.67	1.00
6	112298011	22 宁波银行 CD103	3,000,000	299,580,161.62	0.97
7	112298600	22 中原银行 CD113	3,000,000	299,329,758.36	0.97
8	170412	17 农发 12	2,500,000	259,914,204.30	0.84
9	112298253	22 杭州银行 CD119	2,000,000	199,702,041.86	0.65
10	112298889	22 宁波银行 CD119	2,000,000	199,539,264.58	0.65

## 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0292%
报告期内偏离度的最低值	0.0026%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0147%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期本基金无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

## 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、本基金投资的前十名证券之一 21 农发 07 (210407. IB) 的发行主体中国农业发展银行于 2022 年 3 月 21 日因漏报不良贷款余额 EAST 数据等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2022)10 号)。本基金认为,对中国农业发展银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一 17 农发 12 (170412. IB) 的发行主体中国农业发展银行于 2022 年 3 月 21 日因漏报不良贷款余额 EAST 数据等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2022)10 号)。本基金认为,对中国农业发展银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

3、本基金投资的前十名证券之一 20 进出 12 (200312. IB) 的发行主体中国进出口银行于 2021 年 7 月 13 日因违规投资企业股权等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2021)31 号),于 2022 年 3 月 21 日因漏报不良贷款余额 EAST 数据等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字(2022)9 号)。本基金认为,对中国进出口银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

4、本基金投资的前十名证券中的 22 宁波银行 CD109 (112298211. IB)、22 宁波银行 CD103 (112298011. IB)、22 宁波银行 CD119 (112298889. IB) 的发行主体宁波银行股份有限公司于 2021 年 12 月 29 日因信用卡业务管理不到位,受到宁波银保监局处罚(甬银保监罚决字(2021)81 号)。本基金认为,对宁波银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5、本基金投资的前十名证券之一 22 杭州银行 CD119 (112298253. IB) 的发行主体杭州银行股份有限公司于 2022 年 5 月 23 日因未按规定履行客户身份识别义务,受到中国人民银行杭州中心支行处罚(杭银处罚字(2022)30 号)。本基金认为,对杭州银行的处罚不会对其投资价值构成

实质性负面影响。

6、本基金投资的前十名证券之一 22 深圳农商银行 CD033（112298602.IB）的发行主体深圳农村商业银行股份有限公司于 2022 年 2 月 14 日因贷款“三查”不尽职，贷款资金被挪用等，受到中国银行保险监督管理委员会深圳监管局处罚（深银保监罚决字(2022)19 号）。本基金认为，对深圳农商行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,540.32
2	应收清算款	50,203,004.59
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,482,381.23
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	51,715,926.14

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
大成现金增利货币 A	4,766,425	6,460.08	8,265,535.16	0.03	30,783,219,342.64	99.97
大成现金增利货币 B	26	7,484.71	698.70	0.36	193,903.87	99.64
合计	4,766,451	6,460.09	8,266,233.86	0.03	30,783,413,246.51	99.97

注：持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	个人	43,307,570.21	0.14
2	个人	27,039,914.43	0.09
3	个人	7,915,431.11	0.03
4	个人	7,853,605.85	0.03
5	个人	6,714,323.75	0.02
6	个人	6,296,180.11	0.02
7	个人	5,894,763.13	0.02
8	个人	5,824,760.71	0.02
9	个人	5,106,105.13	0.02
10	个人	5,035,565.00	0.02

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	大成现金增利货币 A	185,294.57	0.0006
	大成现金增利货币 B	0.00	0.0000
	合计	185,294.57	0.0006

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	大成现金增利货币 A	0~10
	大成现金增利货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	大成现金增利货币 A	0
	大成现金增利货币 B	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成现金增利货币 A	大成现金增利货币 B
基金合同生效日 (2012 年 11 月 20)	2,538,753,613.56	2,327,500,035.95

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	30,967,988,187.88	197,189.21
本报告期基金总申购份额	184,983,239,865.01	833,537.91
减: 本报告期基金总赎回份额	185,159,743,175.09	836,124.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,791,484,877.80	194,602.57

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 一、基金管理人的重大人事变动

1. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十四次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 4 月 15 日起，周立新先生因工作安排离任公司副总经理。具体事宜详见公司公告。

2. 根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第七届董事会第十五次会议审议通过并履行必要程序，自 2022 年 6 月 1 日起，赵冰女士担任公司副总经理，段皓静女士担任公司督察长。自同日起赵冰女士离任公司督察长。具体事宜详见公司公告。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-

山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元的变更情况如下：

本报告期内新增交易单元：中信证券、东亚前海；本报告期内退出交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
光大证券	601,041,875.00	100.00	73,385,672,000.00	100.00	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 30 日
2	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 06 月 02 日
3	大成现金增利货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 22 日
4	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 04 月 16 日
5	大成现金增利货币市场基金 2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 29 日
6	大成现金增利货币市场基金 B 类份额增加部分代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 03 月 22 日
7	大成基金管理有限公司关于公司固有资金拟申购旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 27 日
8	大成现金增利货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 01 月 21 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成现金增利货币市场基金的文件；
- 2、《大成现金增利货币市场基金基金合同》；
- 3、《大成现金增利货币市场基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日